

Central Daily Market Report

2018年5月7日(月)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2018年5月7日 需給速報	2018年5月8日 需給予想	2018年5月9日 当社予想
銀行券	3,800	3,100	3,000
財政	▲ 33,600	500	▲ 21,000
資金過不足	▲ 29,800	3,600	▲ 18,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	1,800	▲ 2,000	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		5,000	
国債買入		8,700	
CP等買入		▲ 400	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			
E T F買入			
国債補完供給	▲ 200	200	200
当預増減	▲ 30,000	17,100	▲ 18,000
当座預金残高	3,841,200	3,858,300	3,840,300
準備預金残高	3,374,900		
積み終了先	3,374,700		
超過準備	3,374,700		
非準備預金先	466,300		
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額			3,009,600
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数
			73.33%

●2018年5月7日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、都銀・信託・地銀・証券から▲0.085%近辺の調達希望で始まった。連休による警戒感が剥落したことや、取り調整の動きから徐々に取りが増えたものの、出合いの中心は▲0.085~▲0.08%となった。一巡後も同水準の出合いが散見された。ターム物はロール案件の取引が中心であった。

<レポ市場>

GC T+0(5/7-5/8)は、▲0.08~▲0.055%程度の出合い、T/N(5/8-5/9)は▲0.09~▲0.05%程度での出合い。後決めGCのほうが先決めGCよりもレートが高めとなっている。個別銘柄では、5Y130~135、10Y336~350、30Y58などにビッドの出入りが目立った。

<短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移した。アウトライト市場は、短国買入オペアが5,000億円(前回と同額)でオファーされた。応札額が21,149億円と膨らみ、平均落札利回り較差+0.003%、按分落札利回り較差+0.002%と小甘い結果となった。マーケットでは3M物が▲0.141~▲0.135%で出合った。

<CP市場>

現先レートは低位で推移した。発行市場は、商社から大型案件が見られたが、案件少なく発行総額は800億円程度であった。

●短期金融市場関連指標

2018/5/7	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.072				-	▲ 0.065	0.040	0.000	22,467.16	▲ 5.62	109.13-15	109.19-20
T/N			0.000				-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.037				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.032	0.000	▲ 0.016				-	▲ 0.097						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.105						
1M							-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.137	▲ 0.138						
6M							▲ 0.140	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.148	▲ 0.160						
									日付	4/25	4/26	4/27	5/1	5/2
									日銀当預残	3,872,600	3,873,600	3,885,700	3,872,600	3,871,200
									準備預金残	3,394,000	3,388,000	3,408,100	3,405,100	3,402,100
									マネタリーベース	4,963,700	4,968,000	4,983,800	4,972,800	4,971,400
									無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.071%	▲0.067%	▲0.075%	▲0.075%
									コール市場残高	81,009	76,255	77,827	92,201	98,399
									うち無担	65,350	59,787	56,345	70,575	74,033
									うちO/N	35,000	31,197	27,495	40,833	43,531
									うち有担	15,659	16,468	21,482	21,626	24,366

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	応募率(%)	募入最低額	募入最高利回り	案分率	募入平均価格	募入平均利回り	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回り較差・価格較差	全取レート・利回り較差・価格較差	平均落札レート・利回り較差・価格較差	按分比率
国庫短期証券買入	5,000	2018/5/8			21,149	5,000	0.002		0.003	36.9
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,500	2018/5/8			8,658	2,500	0.000		0.001	27.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,300	2018/5/8			12,195	3,306	▲0.003		▲0.002	36.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,900	2018/5/8			5,316	1,912	0.000		0.001	26.9
国債買入(残存期間25年超)	700	2018/5/8			2,924	706	0.001		0.002	8.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	5,520	2018/5/7	2018/5/8		19	19		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	63,381	2018/5/7	2018/5/8		156	156		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	6,421	2018/5/7	2018/5/8		13	13		▲0.600	▲0.600	

●2018年5月8日の予定

*3月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比+1.1%)	*10年利付国債入札(22,000億円、5/9発行)
	*交付税特別会計借入(10,500億円、5/16借入)

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入